



Tájékoztató a Magyar Nemzeti Bank és az Európai Központi Bank együttműködési megállapodása alapján bevezetésre kerülő eurolikviditást nyújtó jegybanki O/N FX-swap rendelkezésre állásról

A Magyar Nemzeti Bank és az Európai Központi Bank 2008. október 16-i együttműködési megállapodása alapján a Magyar Nemzeti Bank 2008. október 16-ától visszavonásig új eurolikviditást nyújtó egynapos (overnight) futamidejű FX-swap rendelkezésre állást vezet be. A rendelkezésre állás keretében az MNB partnerei minden kereskedési napon előre meghatározott áron helyezhetnek el forintot a jegybanknál euróért cserébe, FX-swap ügyletek keretében. Az ajánlatok fogadási idejét és az előre meghatározott, swappontban kifejezett árat az MNB minden kereskedési napon legkésőbb 11:00 óráig hirdeti meg a Reuters NBHM és a Bloomberg NBH10 oldalán.

Az eurolikviditást nyújtó jegybanki O/N FX-swap rendelkezésre állás keretében kötött ügyletek induló lábán használt technikai árfolyamot az MNB az aktuális piaci árfolyam 110 százalékában állapítja meg. Hasonlóképpen korrigálódik a lejáratú láb is. Az induló láb korrigált árfolyama és az adott partnernek nyújtott euro mennyiség szorzata adja meg azt a forint összeget, amelyet a partnernek az ügylet induló lábán az MNB részére kell nyújtania a számára allokkált devizamennyiségért cserében.

Az MNB az eurolikviditást nyújtó jegybanki O/N FX-swap rendelkezésre állás esetében a fizetés fizetés után (Payment after payment, PaP) elvet alkalmazza, ami azt jelenti, hogy az ügyletből eredő kötelezettségének csak az ügyfél fizetési teljesítésének megtörténte után tesz eleget.

Az eurolikviditást nyújtó jegybanki O/N FX-swap rendelkezésre állás részletes paraméterei és feltételei

Ügylet neve	Eurolikviditást nyújtó O/N FX-swap rendelkezésre állás
Meghirdetés/felhívás időpontja, helye, tartalma	Napi rendelkezésre állás 2008. október 16-tól visszavonásig, a rendelkezésre állás pontos időpontját és az eurolikviditást swappontban kifejezett rögzített árat az MNB minden nap legkésőbb 11:00 óráig hirdeti meg a Reuters NBHM és a Bloomberg NBH10 oldalán
Ügyfélkör	Közvetlen VIBER- vagy BKR tagsággal rendelkező belföldi (tartalékköteles) hitelintézetek
Kezdeményező	Ügyfél
Üzletidő / ajánlatok fogadási ideje	A felhívásban szereplő időpontban

Ajánlatok formai kellei, tartalma	Az ajánlatok Reuters Dealingen nyújthatók be
Beadható ajánlatok száma ajánlattevőnként	Nincs korlát
Ajánlati korlát	Legalább 5 millió euro, 1 millió euro egész számú többszöröseként
Módosítási lehetőség	Nincs
Induló láb pénzügyi teljesítésének / elszámolásának napja	T
Lejárat láb pénzügyi teljesítésének / elszámolásának napja	T+1
Technikai induló árfolyam	Az aktuális árfolyam 110 százaléka
Az MNB-vel szemben fennálló euro fizetési kötelezettség teljesítése	A Magyar Nemzeti Bank forint és külföldi pénznemek között végzett azonnali FX-piaci műveleteire vonatkozó állandó számlakapcsolataiban meghatározott EUR számlára

Az itt nem részletezett kérdésekben „A Jegybank forint- és devizapiaci műveleteinek üzleti feltételei” érvényesek.

Budapest, 2008. október 16.

MAGYAR NEMZETI BANK